



SVILUPPO INIZIATIVE ATTUARIALI

Viale delle Milizie, 1 - 00192 Roma - Tel.: 06 3202922, fax 06 3210250
E-mail: info@sia-attuari.it

Roma, 25 maggio 2018

Prot. n. 016/18

Siamo lieti di informarvi che sono aperte le iscrizioni al 4° corso 2018 di formazione permanente dal titolo: **"Le garanzie finanziarie e le assicurazioni Vita: risvolti sul *pricing* e sul *reserving* alla luce di *Solvency II* ed *IFRS17*"**. Il corso si terrà a **Milano** il **21 giugno 2018** presso Hotel Michelangelo Via Scarlatti, 33 - 20124 Milano.

Il corso si rivolge agli attuari e ad altre figure professionali dotate di conoscenze tecnico-attuariali nel campo delle assicurazioni vita e dei bilanci assicurativi; si propone di illustrare in che modo i proventi finanziari interagiscono con le rivalutazioni delle riserve per determinare il conto economico e variazioni di patrimonio netto. I due punti di vista sono il profit test prima del lancio di un prodotto nuovo e la misurazione dei proventi netti degli investimenti in un bilancio, considerando che i tipi di bilancio sono ormai numerosi, ciascuno dei quali con le proprie regole di valutazione e di rappresentazione.

Presentazione del corso

Conto economico e profitto derivante dai prodotti Vita con prevalenti caratteristiche finanziarie sono per la maggior parte determinate dal gioco e dalla relazione fra redditi e proventi degli investimenti rispetto ai metodi di valutazione delle garanzie finanziarie e costo della capitalizzazione delle riserve tecniche.

I quattro tipi di bilancio (Locale, Solvency II, Consolidato attuale e Consolidato futuro con IFRS9 e IFRS17) propongono regole differenti.

Le conseguenze si riflettono anche nella misurazione a priori della profittabilità dei contratti (profit test) e nel modo in cui mostrare gli effetti dei proventi netti degli investimenti nel conto economico.

La presentazione è in italiano sulla base di materiale scritto in parte in lingua inglese.

Docenti

Dott. Luca Bianchi (Gruppo Aviva. Actuarial Function Holder)

Programma

Prima parte

Indicatori di profittabilità e costo del capitale

Economic Value

Life time EVA

Payback Period

New business Margin

Il costo del requisito di capitale

correlazione e diversificazione

Il conto Economico

Le fondi di profitto e di rischio. Focus su IFRS17

Proventi degli investimenti

I flussi di cassa

Le riserve tecniche

Commissioni ed ammortamenti

Le spese

Fattori biometrici e la decadenza anticipata



Seconda parte

Proventi netti degli investimenti e schemi di conto economico

- Proventi lordi degli investimenti
 - Nel Bilancio Locale, Solvency II, IAS39&IFRS4, IFRS9&IFRS17
- Costo della capitalizzazione della riserva
 - Nel Bilancio Locale, Solvency II, IAS39&IFRS4, IFRS9&IFRS17
- Tasso tecnico e minimo garantito
- La rivalutazione e l'FDB
- Il comportamento dinamico degli assicurati
- Solvency II volatility adjustment
- Gli ESG
- Costo del minimo garantito e TVOG
- L'unwinding del tasso di interesse
 - In IFRS17 (insurance finance expense)
 - Nel Modello generale
 - Effective yield
 - Crediting rate
 - Nel Variable FEE
 - Variable fee e book yield
 - Nel bilancio locale
 - In Solvency II
 - L'experience variance sui rendimenti
 - In IFRS4

Con la partecipazione al corso, che rientra tra le attività preclassificate, come stabilito dalle Linee Guida di attuazione del regolamento sulla Formazione Attuariale Continua, redatto ai sensi dell'art. 7 comma 3 del D.P.R. N. 137/2012, emanate dal Consiglio Nazionale degli Attuari in data 7 maggio 2018, saranno attribuiti **5 (cinque) CFP ai fini FAC** (Formazione Attuariale Continua).

Si allega la scheda di iscrizione che dovrà essere inviata alla Segreteria di S.I.A. entro **giovedì 14 giugno 2018.**

Con l'auspicio che anche questo corso possa dare luogo ad una intensa partecipazione, si inviano cordiali saluti.

Il Presidente
(Giampaolo Crenca)



Sede del corso:

Hotel Michelangelo
Via Scarlatti, 33
20124 Milano

Segreteria operativa:

S.I.A. s.r.l. - Viale delle Milizie 1 - 00192 Roma
Tel. 06.3202922, fax 06.3210250, E-mail: info@sia-attuari.it
Federica Campanini

Orario:

Giovedì 21 giugno 2018

09.15 – 09.30 Registrazione
09.30 – 11.00 Lezione
11.00 – 11.15 Pausa caffè*
11.15 – 13.00 Lezione
13.00 – 14.00 Intervallo
14.00 – 15.30 Lezione
15.30 – 15.45 Pausa caffè*
15.45 – 17.15 Lezione

* Presso Hotel Michelangelo

Numero dei partecipanti:

Il numero massimo di partecipanti è fissato in 30 unità, ammessi secondo l'ordine cronologico di ricevimento della domanda.

Iscrizioni:

La scheda allegata va inviata alla segreteria della S.I.A. s.r.l., Viale delle Milizie 1, 00192 Roma, tramite email, **entro giovedì 14 giugno 2018. L'iscrizione al corso sarà confermata con nostra email.**

Quota di iscrizione:

La quota di iscrizione per ogni partecipante è di **Euro 500,00 + IVA**. La quota dà diritto alla partecipazione ai lavori, al materiale didattico, alle due pause caffè giornaliere.

Modalità di pagamento:

Il versamento della quota di iscrizione, da effettuarsi successivamente alla nostra conferma, dovrà pervenire entro e non oltre l'inizio del corso, con l'evidenza del corrispondente numero di fattura.

Eventuali rimborsi per impedita partecipazione saranno consentiti nella misura dell'80% se la mancata partecipazione sarà comunicata per iscritto almeno 2 giorni prima dell'inizio del corso.



4° CORSO 2018 DI FORMAZIONE PERMANENTE

sul tema

**“Le garanzie finanziarie e le assicurazioni Vita: risvolti sul *pricing* e sul *reserving*
alla luce di *Solvency II* ed *IFRS17*”**

Milano, 21 giugno 2018

IL SOTTOSCRITTO (Dott., Prof., Sig.)

ATTUARIO: - OPERATORE FINANZIARIO: - INTERMEDIARIO: - ALTRO:

INDIRIZZO

CAP CITTA' PROV

TELEFONO FAX E-MAIL

SOCIETA' O ENTE DI APPARTENENZA.....

Intende partecipare al 4° Corso 2018 di Formazione Attuariale Permanente. Al tal fine effettua il pagamento della quota di iscrizione mediante versamento sul c/c BNL: **IBAN: IT88F 01005 03240 00000 0021725** intestato alla S.I.A. s.r.l.

La fattura va intestata a:

Partita IVA n. Cod. Fisc.
(si prega di indicare sia partita IVA che codice fiscale anche se coincidenti)

La fattura va inviata a:

INDICARE SE LA FATTURA DEVE ESSERE IN REGIME DI SPLIT PAYMENT SI NO

Data

FIRMA

.....

.....

1.1 **Oggetto: Informativa ai sensi dell'art. 13 Decreto Legislativo n 196 del 2003**

Questa informativa viene fornita ai sensi dell'art. 13 del Decreto Legislativo 196 del 2003 (di seguito Codice privacy), dettato in materia di “protezione dei dati personali”. Secondo la legge indicata, tale trattamento sarà improntato ai principi di correttezza, liceità e trasparenza e di tutela della Sua riservatezza e dei Suoi diritti.

Ai sensi dell'articolo 13 del Codice privacy, **Sviluppo Iniziative Attuariali S.r.l. (in seguito anche SIA)** con sede legale in Viale delle Milizie, 1, 00192 Roma, Titolare del trattamento, Le fornisce quindi le seguenti informazioni:

- il trattamento dei suoi dati personale è effettuato per:
 - la gestione e l'organizzazione dei corsi, per la sua iscrizione e per l'esecuzione delle attività amministrative, fiscali e contabili collegate;
 - l'invio, anche per e-mail, di comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi;
 - il trattamento sarà effettuato con strumenti automatizzati e manuali;
 - il conferimento dei dati di cui al punto a. è necessario e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di partecipare all'attività formativa; il conferimento dei dati di cui al punto b. è facoltativo e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di inviare comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi;
 - i dati, che non saranno diffusi, potranno essere comunicati, a soggetti terzi per l'adempimento delle finalità su menzionate, a società che si occupano di formazione e aggiornamento professionale e a soggetti cui la facoltà di accedere ai dati sia riconosciuta da disposizioni di legge e/o di normativa secondaria;
 - gli incaricati che si occupano della gestione degli iscritti potranno venire a conoscenza dei suoi dati personali esclusivamente per le finalità su menzionate;
- La informiamo, infine che potrà esercitare, i diritti contemplati dall'art. 7 del Codice privacy, tra cui quello di ottenere dal Titolare del trattamento, la conferma dell'esistenza o meno di Suoi Dati personali e di consentirLe, nel caso, la messa a disposizione scrivendo all'indirizzo e-mail info@sia-attuari.it. Lei potrà pertanto chiedere di avere conoscenza dell'origine dei dati nonché della logica e delle finalità del Trattamento; di ottenere la cancellazione, la trasformazione in forma anonima o il blocco dei dati trattati in violazione di legge, nonché l'aggiornamento, la rettifica o, se vi è interesse, l'integrazione dei dati stessi; di opporsi, per motivi legittimi, al trattamento.

Roma, 19 dicembre 2016

Il Titolare del trattamento
Sviluppo Iniziative Attuariali s.r.l.

Consenso al trattamento dei dati personali

Il/La sottoscritto/a conferma di aver letto con attenzione l'informativa su esposta e conferisce il consenso al trattamento dei suoi dati personali per l'invio, anche per e-mail, di comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi.

Data

Firma